

尊敬的客户：

为保障您的合法权益，敬请您逐字逐句地认真阅读本合同的全部文件内容。本合同的所有内容都与您的利益息息相关。如有任何疑问，敬请垂询。我公司将竭诚为您服务。

本合同已于 2013 年 2 月 5 日获得中国期货业协会关于本合同文本备案审查合格的通知（协会发文号：中期协函字[2013]31 号），系本公司正在使用的最新文本。

中证期货有限公司

目 录

期货交易风险说明书	2
客户须知	4
期货经纪合同	6
第一节 合同订立前的说明、告知义务	6
第二节 委托	6
第三节 保证金及其管理	6
第四节 交易指令的类型及下达	6
第五节 交易指令的执行与错单处理	7
第六节 通知与确认	7
第七节 风险控制	7
第八节 异常交易报备	8
第九节 现货月份平仓和交割	8
第十节 信息、培训与咨询	8
第十一节 费用	8
第十二节 合同生效与变更	8
第十三节 合同终止与账户清算	9
第十四节 免责条款	9
第十五节 争议解决	9
第十六节 其他	9
附件：开户回执	10

期货交易风险说明书

市场风险莫测 务请谨慎从事

尊敬的客户：

根据中国证监会的规定，现向您提供本《期货交易风险说明书》。

进行期货交易风险相当大，可能发生巨额损失，损失的总额可能超过您存放在期货公司的全部初始保证金以及追加保证金。因此，您必须认真考虑自己的经济能力是否适合进行期货交易。

考虑是否进行期货交易时，您应当明确以下几点：

一、您在期货市场进行交易，假如市场走势对您不利导致您的账户保证金不足时，期货公司会按照期货经纪合同约定的时间和方式通知您追加保证金，以使您能继续持有未平仓合约。如您未于规定时间内存入所需保证金，您持有的未平仓合约将可能在亏损的情况下被强行平仓，您必须承担由此导致的一切损失。

二、您必须认真阅读并遵守期货交易所和期货公司的业务规则，如果您无法满足期货交易所和期货公司业务规则规定的要求，您所持有的未平仓合约将可能根据有关规则被强行平仓，您必须承担由此产生的后果。

三、在某些市场情况下，您可能会难以或无法将持有的未平仓合约平仓。例如，这种情况可能在市场达到涨跌停板时出现。出现这类情况，您的所有保证金有可能无法弥补全部损失，您必须承担由此导致的全部损失。

四、由于国家法律、法规、政策的变化、期货交易所交易规则的修改、紧急措施的出台等原因，您持有的未平仓合约可能无法继续持有，您必须承担由此导致的损失。

五、由于非期货交易所或者期货公司所能控制的原因，例如：地震、水灾、火灾等不可抗力因素或者计算机系统、通讯系统故障等，可能造成您的指令无法成交或者无法全部成交，您必须承担由此导致的损失。

六、在国内期货交易中，所有的交易结果须以当日交易所或结算机构的结算数据为依据。如果您利用盘中即时回报的交易结果作进一步的交易，您可能会承担额外的风险。

七、“套期保值”交易同投机交易一样，同样面临价格波动引起的风险。

八、如果您未遵守中国证监会关于期货保证金安全存管的规定，将可能会影响您的期货保证金的安全性。

九、利用互联网或其他方式进行期货交易时将存在(但不限于)以下风险，您将承担由此导致的损失：

1. 由于无法控制和不可预测的系统故障、设备故障、通讯故障、电力故障、网络故障及其它因素，可能导致交易系统非正常运行甚至瘫痪，使您的交易指令出现延迟、中断、数据错误等情况；

2. 由于网上交易系统存在被网络黑客和计算机病毒攻击的可能性，由此可能导致交易系统故障，使交易无法进行及行情信息出现错误或延迟；

3. 互联网上的数据传输可能因通信繁忙等原因出现延迟、中断、数据错误或不完整，从而使网上交易出现延迟、中断；

4. 如果您缺乏网上交易经验，可能因操作不当造成交易失败或交易失误；

5. 您的密码失密或被他人盗用。

本《期货交易风险说明书》无法揭示从事期货交易的所有风险和有关期货市场的全部情形。故您在入市交易之前，应全面了解期货交易法律法规、期货交易所规则及期货公司的业务规则，对自身的经济承受能力、风险控制能力、身体及心理承受能力（仅对自然人客户而言）作出客观判断，对期货交易作仔细的研究。

以上《期货交易风险说明书》的各项内容，本人/单位已阅读并完全理解。

（请完整抄写以上划线部分）

客户签字：

（机构加盖公章）

签署日期： 年 月 日

客户须知

一、客户需具备的开户条件

客户应是具备从事期货交易主体资格的自然人、法人或其他经济组织。

自然人开户须是年满十八周岁、具有完全民事行为能力的公民。

客户须以真实的、合法的身份开户。

客户须保证资金来源的合法性。客户须保证所提供的营业执照、身份证及其他有关资料的真实性、合法性、有效性。

二、开户文件的签署

自然人开户的必须由客户本人签署开户文件，不得委托代理人代为办理开户手续。

法人、其他经济组织等机构客户开户可委托代理人办理开户手续、签署开户文件。由委托代理人开户的机构客户应向公司提供真实、合法、有效的开户代理人授权委托书。

三、客户需知晓的事项

（一）知晓期货交易风险

客户应知晓从事期货交易具有风险。客户应在开户前对自身的经济承受能力和心理承受能力做出客观判断，应仔细阅读并签字确认《期货交易风险说明书》。

（二）知晓期货交易规则

客户应知晓期货法规和期货交易规则。期货法规和各期货交易所的期货交易规则在各期货交易所网站进行公示，客户应在交易前学习、掌握期货法规和期货交易规则，并在交易过程中严格遵守。

（三）知晓期货公司不得做获利保证

客户应知晓期货交易中任何获利或者不会发生损失的承诺均为不可能或者是没有根据的，期货公司不得与客户约定分享利益或共担风险。客户所有交易均属客户自主操作，全部结果均由客户自行承担。

（四）知晓经纪业务中期货公司不得接受客户的全权委托

客户应知晓在经纪业务中，期货公司及其工作人员不得接受客户的全权委托，客户也不得要求期货公司或其工作人员以全权委托的方式进行期货交易。全权委托指期货公司代客户决定交易指令的内容。客户若私下委托期货公司员工操作，属于其个人行为，期货公司不负任何责任并可追究其违规责任。

（五）知晓客户本人须对其代理人的代理行为承担民事责任

客户代理人是基于客户的授权，代表客户实施民事行为的人，代理人在代理权限内以客户名义进行的行为即视为客户自己的行为，代理人向客户负责，客户对代理人代理行为的后果承担一切责任。

（六）知晓从业人员资格公示网址

知晓期货公司期货从业人员的信息可以通过中国期货业协会网站（www.cfachina.org）的从业人员执业资格公示数据库进行查询和核实。

（七）知晓期货保证金安全存管的有关规定

为保障期货保证金的安全，客户应当知晓并遵守中国证监会有关期货保证金存取的规定，应当确保将资金直接存入中国期货保证金监控中心公告的期货公司的期货保证金账户，期货保证金的存取应当通过客户在期货公司登记的期货结算账户和期货公司的期货保证金账户转账办理。

客户可以登录中国期货保证金监控中心有限责任公司（以下简称中国期货保证金监控中心）网站（www.cfmmc.com），了解有关期货公司的期货保证金账户信息以及期货公司为客户提供的结算信息。

（八）知晓密码的使用及管理

客户会同时获取客户资金账号及相对应的初始交易密码、初始资金密码，及中国保证金监控中心查询系统的用

户名、初始密码。获取账号视同已获取相对应的密码。客户知晓在入金前更改上述密码，办理入金后即被视为已修改初始密码。

客户应避免使用客户证件号码、简单数字作为使用密码，并有义务妥善保管自己的交易密码、资金密码、保证金监控中心密码。因客户未能妥善保管上述密码而造成的一切后果由客户自行承担。

(九) 知晓从事中间介绍业务证券公司的有关规定

客户应知晓只有取得中间介绍业务资格的证券公司方可从事中间介绍业务。证券公司从事中间介绍业务限于以下服务内容：

1. 协助办理开户业务；
2. 提供期货行情信息、交易设施；
3. 在市场行情发生重大变化或者客户可能出现风险时，协助期货公司向客户提示风险；
4. 中国证监会规定的其他服务。

从事中间介绍业务的证券公司不得代客户进行期货交易、结算或交割，不得收付期货保证金，不得代客户接收、保管或者修改交易密码，不得为客户从事期货交易提供融资或担保，不得利用客户的交易编码、资金账号或者期货结算账户进行期货交易。

(十) 知晓各交易所规定的异常交易行为以及认定标准和处理程序

客户应知晓各交易所规定的异常交易行为以及认定标准和处理程序，知晓期货公司对异常交易行为的管理职责，在客户出现交易所规定的异常交易行为并经劝阻、制止无效的，期货公司可以对客户采取提高交易保证金、限制开仓、拒绝委托以及终止经纪关系等相应措施。客户应承担因违法违规行为产生的全部损失和法律责任。

(十一) 知晓居间人的定义和责任

居间人是指促进合同签订的服务方，促成合同签署后收取相应报酬，居间人是独立于期货公司和客户的法律主体，应独立承担一切民事责任。

如客户委托居间人进行交易，其操作引起的一切损失及法律责任均由客户本人承担。

(十二) 知晓期货公司通知事项查询方式

期货公司通知事项包括并不限于交易所交易规则变更通知，期货公司保证金、手续费等交易和结算参数调整通知，客户交易结算报告，追加保证金通知，强行平仓通知，期货公司交易系统、行情系统、网站变更通知。期货公司将通过公司网站 (www.citicsf.com)、行情系统等方式向客户发布不涉及客户私有交易情况的通知事项。期货公司将通过中国期货保证金监控中心客户查询系统 (www.cfmmc.com) 向客户单独发布客户交易结算报告、追加保证金通知、强行平仓通知、调整保证金通知等通知事项。期货公司将通过本合同约定的通知方式向客户发布单独调整保证金通知。期货公司通过上述方式发布通知事项即视为期货公司履行了对客户的通知义务。

(十三) 知晓期货公司风险控制原则

客户通过期货公司进行期货交易应知晓期货公司承担了风险控制责任，期货公司有权在期货法律法规许可的范围内按照双方通过《期货经纪合同》约定的风险控制条件实施相应风险控制措施。期货公司按照约定的条件实施的风险控制措施产生的一切责任、损失和费用由客户自行承担。

以上《客户须知》的各项内容，本人/单位已阅读并完全理解。

(请完整抄写以上划线部分)

客户签字：
(机构加盖公章)
签署日期： 年 月 日

中证期货有限公司期货经纪合同

甲方：中证期货有限公司

乙方：_____

甲、乙双方经过平等协商，根据《期货交易管理条例》及相关管理办法，就甲方为乙方提供期货交易服务的有关事项订立本合同。

第一节 合同订立前的说明、告知义务

第一条 在签署本合同前，甲方已向乙方出示了《期货交易风险说明书》及《客户须知》，并充分说明了期货交易的风险。乙方已仔细阅读、理解并签署了上述文件的内容。

第二条 乙方应在签署本合同前仔细阅读所有条款，特别是有关甲方的免责条款，并准确理解其含义。

第三条 乙方以自己的名义委托甲方从事期货交易，保证所提供的证件及资料具有真实性、合法性及有效性。同时乙方声明并保证不具有下列情形：

- (一) 无民事行为能力或者限制民事行为能力的自然人；
- (二) 中国证监会、中国期货业协会、期货交易所、期货保证金安全存管监控机构、期货公司的工作人员及其配偶；
- (三) 国家机关、事业单位；
- (四) 证券、期货市场禁止进入者；
- (五) 未能提供开户证明文件的单位或个人；
- (六) 中国证监会规定不得从事期货交易的其他单位或个人。

如果以上声明部分或全部不真实，乙方承担由此产生的全部法律责任并自行承担由此造成的一切损失。

第四条 合同生效后，乙方提供给甲方的证件或者资料发生变更，或者超过有效期，乙方应当及时以书面的方式通知甲方并更新相关资料。根据中国证监会关于历史账户规范与清理的管理规定，乙方期货账户如满足休眠处理条件的，甲方有权根据监管要求限制账户的开仓权限或对乙方资金账户和交易编码进行交易权限冻结处理。

第五条 甲方应当在营业场所备置期货交易法律法规、各期货交易所规则、甲方业务规则等相关文件，并公开甲方从业人员名册及从业人员资格证明等资料供乙方查阅。乙方可以向甲方询问上述规则的含义，对于乙方的询问甲方应当详细解释。

第二节 委托

第六条 乙方委托甲方按照乙方交易指令为乙方进行期货交易；甲方接受乙方委托，并按照乙方交易指令为乙方进行期货交易。

甲方根据期货交易所规则执行乙方交易指令，乙方应当对交易结果承担全部责任。

第七条 乙方所选择的代理人（包括开户代理人、指令下达人、资金调拨人、结算单确认人）均非甲方工作人员，代理人在乙方授权范围内所做出的任何行为均代表乙方行为，乙方应承担由此产生的全部责任。

第八条 乙方如变更代理人，应当书面通知甲方并经甲方确认。乙方是机构客户的，乙方的法定代表人或者负责人应当在变更通知上签署并加盖公章。

第三节 保证金及其管理

第九条 甲方在期货保证金存管银行开设期货保证金账户，代管乙方交存的保证金。乙方可以通过中国期货保证金监控中心的网站(www.cfmmc.com)查询甲方的期货保证金账户。

第十条 乙方的出入金通过其在开户申请表中登记的期货结算账户与期货公司在同一期货保证金存管银行开设的期货保证金账户以同行转账的形式办理。乙方的出入金方式应符合中国证监会及期货保证金存管银行资金结算的有关规定。

乙方可通过银期转账、网银、电汇等方式办理出入金。乙方办理银期转账签约手续可向甲方开户人员咨询。

第十一条 乙方应当保证其资金来源的合法性。甲方有权要求乙方对资金来源的合法性进行说明，必要时可以要求乙方提供相关证明。

乙方对其所做的说明及提供的证明文件负有保证义务，并承担相应的法律责任。

第十二条 乙方交存的保证金属于乙方所有，除下列可

划转情形外，甲方不得挪用乙方保证金：

(一) 依照乙方或乙方授权的资金调拨人的指示支付可用保证金；

(二) 为乙方交存保证金或者结算差额；

(三) 为乙方支付交割货款或者乙方未履约情况下的违约金；

(四) 为乙方支付的仓储费或相关费用；

(五) 乙方应当支付的手续费、税款及其他费用；

(六) 乙方因违法、违规被监管部门或期货交易所处罚的罚款；

(七) 有关法律、法规或中国证监会、期货交易所规定的其他情形。

第十三条 乙方可以根据期货交易的规则以标准仓单、国债等价值稳定、流动性强的有价证券交纳保证金。甲方应按照期货交易所规则的要求代为办理。

第十四条 甲方有权根据期货交易所、结算机构的规定、市场情况，或者甲方认为有必要时自行调整保证金比例。甲方调整保证金比例时，以甲方发出的调整保证金公告或者通知为准。

当甲方认为乙方持有的未平仓合约风险较大、乙方存在异常交易情况或根据客户反洗钱风险分级管理制度规定，甲方有权对乙方采取单独提高保证金比例、暂停出入金或者拒绝开仓等措施。在此种情形下，提高保证金、暂停出入金或者拒绝开仓等措施的通知单独对乙方发出。

第十五条 乙方承诺在进行资金划转前已核准和确认账号资金及交易情况。甲方接收到乙方的划转资金指令时，均视为乙方对以往的全部交易和资金情况表示确认，无任何异议。

甲方根据乙方的保证金是否充足、指令内容是否齐全和明确、是否违反有关法规和交易所规则、是否存在洗钱嫌疑、是否正在被司法机关或监管部门调查等，来审核乙方的交易指令或资金调拨指令是否有效。当确定乙方的指令为无效指令时，甲方有权拒绝或暂缓执行乙方的指令。

第十六条 甲方应当对乙方期货结算账户的有关信息保密，但国家法律法规和中国证监会特别规定的除外。为保障乙方保证金的安全，乙方同意甲方按照中国证监会的规定或要求，向中国期货保证金监控中心报送乙方与保证金安全存管相关的信息。

第四节 交易指令的类型及下达

第十七条 乙方可以通过电子、电话、书面或双方认可的其他方式向甲方下达交易指令。乙方下达的交易指令类型应当符合各期货交易所及甲方的相关规定。

乙方通过电子方式下达交易指令是指乙方使用甲方发布的交易系统、交易接口或语音电话自助委托系统通过计算机网络（包括互联网、局域网等）或通讯网络向甲方下达交易指令，进行期货交易的交易方式，简称电子交易。

第十八条 乙方进行电子交易的，应当按照系统、接口要求以自己的资金账号（即客户账号）、交易密码等下达交易指令。凡使用乙方的密码所进行的一切交易及出入金，均视为乙方亲自办理。

第十九条 乙方进行电子交易的，甲方交易服务器内的委托记录将作为甲乙双方核查交易指令合法、有效的证明。乙方同意，甲方交易服务器内的交易记录与书面指令具有同等法律效力。

第二十条 由于电子交易受各种因素的影响存在中断的可能性，为保证乙方交易的正常进行，甲方为乙方提供备用下单方式，如因乙方的设备或网络不能正常进行交易时，可改作电话或书面等其他方式下单。

第二十一条 乙方通过电话方式下达交易指令的，甲方按照资金账号、名称或姓名、联系方式、证件号码等要素核实乙方身份。乙方同意，只要以上任意三项相符，相应的交易指令就视为乙方下达。

以电话方式下达交易指令的，甲方有权进行同步录音保留原始交易指令记录。乙方同意，甲方的录音记录将作为甲

乙双方核查交易指令合法、有效的证明，书面指令具有同等法律效力。

第二十二條 乙方以书面方式下达交易指令的，交易指令单的填写应完整、准确、清晰，并由乙方或者乙方指令下达人签字（及/或盖章）。书面下单方式仅限于期货公司营业场所内的客户。

第二十三條 甲方为乙方提供客户账号的同时为乙方设置初始交易密码、初始资金密码，乙方同意以其身份证（乙方为机构客户则采用营业执照）后六位数字作为初始交易密码和初始资金密码。甲方通过开户回执约定的方式通知乙方交易系统和行情系统的下载安装方式以及初始交易密码、初始资金密码、中国期货保证金监控中心查询系统用户名和初始密码等信息。乙方收到开户回执即表示乙方获得交易系统权限，乙方应立即更改所有初始密码。乙方只要完成第一次入金，甲方视乙方已修改上述初始密码。乙方应尽量避免使用证件号码、简单数字作为使用密码。乙方有义务妥善保管自己的交易密码、资金密码、保证金监控中心密码。因乙方未能妥善保管上述密码而造成的一切后果由乙方自行承担。

第五节 交易指令的执行与错单处理

第二十四條 乙方下达的交易指令应当包括乙方资金账号（或交易编码）、品种、合约、数量、买卖方向、价格、开平仓方向等内容。甲方有权审核乙方的交易指令，包括但不限于保证金是否充足，指令内容是否明确，是否违反有关法律法规和期货交易规则等，以确定指令的有效性。当确定乙方的指令为无效指令时，甲方有权拒绝执行乙方的指令。

第二十五條 乙方在发出交易指令后，可以在指令全部成交之前向甲方要求撤回或者修改指令。但如果该指令已经在期货交易所全部或部分成交的，乙方则应当承担交易结果。

第二十六條 由于市场原因或者其他非甲方所能预见、避免或控制的原因导致乙方交易指令全部或者部分无法成交的，甲方不承担责任。

第二十七條 甲方错误执行乙方交易指令，除乙方认可的以外，交易结果由甲方承担。

第六节 通知与确认

第二十八條 甲方通知事项包括并不限于交易所交易规则变更通知，保证金、手续费等交易和结算参数调整通知，交易结算报告，追加保证金通知，强行平仓通知，交易系统、行情系统、网站等变更通知。

第二十九條 甲方将通过公司网站、行情系统等方式向乙方发布不涉及乙方私有交易情况的通知事项。甲方将通过中国期货保证金监控中心查询系统向乙方单独发布乙方的交易结算报告、追加保证金通知、强行平仓通知、调整保证金通知等通知事项。甲方将通过本合同约定的通知方式向乙方发布单独调整保证金通知。

甲方通过本条款上述方式发布通知事项即视为甲方履行了对乙方的通知义务，无论乙方是否通过上述通知事项发布方式查看通知事项，均不能影响甲方通知义务的履行结果。

第三十條 双方约定利用中国期货保证金监控中心查询系统作为甲方向乙方发送交易结算报告、调整保证金通知、追加保证金通知、强行平仓通知等通知事项的主要通知方式。甲方除采用中国期货保证金监控中心查询系统作为主要通知方式外，同时采用以下辅助通知方式向乙方发送每日交易结算报告、追加保证金通知、单独调整保证金通知等文件：

（一）甲方为乙方提供的交易系统查询；

（二）乙方到甲方柜台签领甲方通知。

第三十一條 甲方应在每日结算完成以后，及时将乙方账户的交易结算报告、调整保证金通知、追加保证金通知等文件发送到中国期货保证金监控中心。

第三十二條 甲方对乙方的期货交易实行当日无负债结算。只要乙方在该交易日有交易、有持仓或者有出入金的，甲方均应在当日结算后按照本合同约定的方式向乙方发出显示其账户权益状况和成交结果的交易结算报告。

乙方同意在没有交易、持仓及出入金时，甲方可以不对乙方发出交易结算报告，除非乙方特别要求。

第三十三條 中国期货保证金监控中心的网址为 www.cfmmc.com，乙方应及时登录中国期货保证金监控中心查询系统，接收甲方发出的交易结算报告、调整保证金通知、追加保证金通知等文件，查询交易、盈亏、资金、持仓、权益等账户情况。乙方应遵照中国期货保证金监控中心的有关规定，及时修改密码，防止密码被盗风险。

第三十四條 由于中国期货保证金监控中心查询系统只保存最近 2 个月的投资者账户信息；在乙方销户以后，查询系统也会相应取消对乙方的查询服务，因此，乙方应及时将接收到的结算报告或通知书打印或者下载保存。

第三十五條 由于中国期货保证金监控中心查询系统与甲方采用的交易结算系统不同，甲方着重提示乙方应注意二者在格式、公式、概念上的区别，以免对资金账户的状况产生误解，造成不必要的损失。甲方交易结算报告采用逐日盯市方式计算盈亏，查询系统则提供两种方式：逐日盯市和逐笔对冲。

第三十六條 乙方有义务随时关注自己的交易结果并妥善处理持仓，如果乙方因某种原因无法收到或者没有收到当日交易结算报告的，应于下一个交易日开市前 30 分钟向甲方提出，否则，视同乙方收到当日交易结算报告。乙方提出未收到交易结算报告的，甲方应及时补发。

乙方在交易日开市前 30 分钟未对前一日交易结算报告提出异议的，视为乙方对交易结算报告记载事项的确认。异议应由乙方本人或其授权的指令下达人以书面方式（传真或当面提交）向甲方提出，甲方应及时处理所收到的书面异议。

第三十七條 乙方进行资金划转、交易或者对当日交易结算报告的确认，均视为乙方对该日及该日之前所有持仓和交易结算结果、资金存取的确认。

第三十八條 由于甲方原因导致交易结算报告的记载事项出现与实际交易结果和权益不符的，乙方的确认不改变乙方的实际交易结果和权益。对于不符事项，甲、乙双方可以根据原始财务凭证及交易凭证另行确认。

第三十九條 乙方在本合同约定的时间内以约定方式向甲方提出书面异议的，甲方应当根据原始指令记录和交易记录及时核实。当对与交易结果有直接关联的事项发生异议时，为避免损失的可能发生或者扩大，甲方在收到乙方的异议时，可以将发生异议的持仓合约进行平仓或者重新执行乙方的交易指令。由此发生的损失由有过错一方承担。

第四十條 交易结果不符合乙方的交易指令，甲方有过错的，除乙方认可外，甲方应当在下一交易日闭市前重新执行乙方交易指令，或者根据乙方的意愿采取其他合理的解决办法，并赔偿由此造成的直接损失。

第四十一條 乙方要求变更本节通知方式的，应当及时书面通知甲方，并经甲方确认后生效。

第七节 风险控制

第四十二條 乙方在其交易及持仓过程中，应当随时关注自己的交易状况以及持仓、保证金和权益变化情况，并及时有效的处理自己的交易持仓风险。

第四十三條 甲方以风险度对乙方在不同期货交易场所的未平仓合约统一计算风险。风险度的计算方法为：

$$\text{风险度} = \text{权益} \div \text{持仓保证金} \times 100\%$$

第四十四條 根据乙方的资金情况，可分为三种风险状态：

一是正常状态，是指乙方风险度大于 100% 时，乙方风险状态为正常；二是追加状态，是指乙方风险度小于等于 100% 并且客户权益大于等于按照交易所保证金标准计算的持仓保证金；三是强平状态，是指乙方风险度小于等于 100% 并且乙方权益小于按照交易所保证金标准计算的持仓保证金。

第四十五條 交易所开市期间，如果按照动态成交价计算乙方处于追加状态时，乙方应自行追加资金或减仓。

结算时，乙方如处在追加状态，甲方将通过中国期货保证金监控中心查询系统当日结算报告向乙方发出追加保证金通知。乙方应在下一交易日开市前补足保证金或在开市后立即自行减仓，否则甲方可根据市场状况对乙方的部分或全

部未平仓合约强行平仓。

第四十六条 交易所开市期间,按照动态成交价或动态结算价计算乙方处于强平状态时,乙方必须立即补足保证金或立即采取有效减仓措施,不得以“不在场,不知情”等为由放弃风险处置义务、拖延风险处置时间。若乙方不能及时处置期货账户风险时,即视为乙方认可并授权甲方根据市场情况选择时机对乙方的部分或全部未平仓合约强行平仓,乙方承担由此产生的全部结果。

结算时,乙方如处在强平状态,甲方将通过中国期货保证金监控中心查询系统当日结算报告向乙方发出强平通知,乙方应在下一交易日开市集合竞价前补足保证金或在开市后立即自行减仓,否则即视为乙方认可并授权甲方根据市场情况选择时机对乙方的部分或全部未平仓合约强行平仓;如果当日乙方持有的未平仓合约出现单边市或其他紧急情况时,甲方保留在下一交易日集合竞价时段对乙方部分或全部未平仓合约强行平仓的权利。乙方承担由上述情况产生的全部结果。

第四十七条 在期货交易所限仓的情况下,当乙方持有的未平仓合约数量超过限仓规定时,甲方有权按照期货交易所的限仓规定对其超量部分进行强行平仓;在乙方持有的临近交割月合约未平仓部分不符合期货交易所规定的持仓数量时,甲方有权按照期货交易所对交割月合约持仓数量的要求进行强行平仓。乙方应承担由上述情况产生的结果。

第四十八条 在期货交易所或结算机构根据有关规定要求甲方对乙方持有的未平仓合约强行平仓的情况下,甲方有权未经乙方同意按照期货交易所或结算机构的要求和甲方相关规则对其持有的未平仓合约强行平仓。乙方应承担由此产生的结果。

第四十九条 当甲方依法或者依约定强行平仓时,会在认为合适的时机、品种、价位对乙方部份或全部未平仓合约进行强行平仓。乙方应承担强行平仓的手续费及由此产生的结果。

第五十条 只要甲方选择的平仓价位和平仓数量在当时的市场条件下属于合理的范围,乙方同意不以强行平仓的时机未能选择最佳价位和数量为向甲方主张权益。

第五十一条 甲方强行平仓不符合法定或者约定条件并有过错的,除乙方认可外,应当在下一交易日闭市前恢复被强行平仓的头寸,或者根据乙方的意愿采取其他合理的解决办法,并赔偿由此给乙方造成的直接损失。

第五十二条 由于市场原因导致甲方无法采取强行平仓措施产生的损失由乙方承担。

第五十三条 甲方在采取本节规定的强行平仓措施后,应在事后及时将有关情况告知乙方。

第八节 异常交易管理

第五十四条 当乙方存在对他人(包括个人、单位)期货账户或他人(包括个人、单位)对乙方期货账户具有管理、使用、收益或者处分等权限,从而对交易决策拥有决定权的行为或事实情形的,乙方应主动向甲方陈述,并配合甲方根据期货交易所等机构的要求进行实际控制关系的申报及相应监管措施。如未主动申报,乙方应承担由此产生的所有结果。

第五十五条 乙方进行程序化交易的,应当主动通过甲方向期货交易所申报。如未主动申报,乙方应承担由此产生的所有结果。

第五十六条 乙方在交易过程中应严格遵守各交易所的异常交易监控规定,乙方所有的交易指令均需符合交易所关于异常交易监控规定的合规要求。当乙方交易被期货交易所认定为异常交易行为,导致甲方或期货交易所对乙方账户采取相应监管等措施的,乙方应承担由此产生的所有结果。

第九节 现货月份平仓和交割

第五十七条 乙方申请实物交割的,应当在期货交易所规定的期限前五个交易日向甲方提出书面申请,并经甲方按规定程序确认。乙方申请实物交割,应符合期货交易所的相关规定。否则,甲方有权拒绝接受乙方的实物交割申请。

第五十八条 乙方申请实物交割的,应当在甲方规定的期限前向甲方提交足额的交割保证金或者有效的标准仓单等期货交易要求的凭证或票据,并保证资金来源的合法性和凭证、票据的真实性。超过上述规定的期限,乙方未下达平仓指令,也未向甲方提交足额的交割保证金、凭证或票据的,甲方有权在未通知乙方的情况下,对乙方的未平仓合约进行平仓,由此产生的费用和结果由乙方承担。

第五十九条 交割通知、交割货款的交收、实物交付及交割违约的处理办法,依照相关期货交易所和甲方的交割业务规则执行。

第六十条 乙方进行股指期货交易的,最后交易日闭市后所有未平仓合约均自动进入交割程序,交割按交易所和甲方的相关业务规则执行。

第六十一条 乙方若申请套期保值额度,应当按照期货交易所的相关规定向甲方提供相应的文件或者证明,并对相应文件的真实性、有效性负责。甲方应当协助乙方申请套期保值额度。套期保值额度的确定以期货交易所批准的为准。

第十节 信息、培训与咨询

第六十二条 甲方应当在其营业场所或者网站向乙方提供国内期货市场行情、信息及与交易相关的服务。甲方提供的任何关于市场的分析和信息仅供乙方参考,不构成对乙方下达指令的指示、诱导或者暗示。乙方应当对自己的交易行为负责,不能以根据甲方的分析或者信息入市为理由,要求甲方对其交易亏损承担责任。

第六十三条 甲方可以以举办讲座、发放资料或其他方式向乙方提供期货交易知识和交易技术的培训服务。乙方有权向甲方咨询有关期货交易的事项,甲方应予以解释。

第六十四条 乙方应当及时了解期货监管部门及相关期货交易所的法律、法规和规则,并可要求甲方对上述内容进行说明。

第六十五条 乙方有权查询自己的原始交易凭证,有权了解自己的账户情况,甲方应当给予积极配合。

第六十六条 有关甲方期货从业人员的信息可以通过中国期货业协会网站(www.cfachina.org)的期货从业人员执业资格公示数据库进行查询。甲方应当在其营业场所提供必要的设备,以便乙方登陆中国期货业协会网站查询期货从业人员资格公示信息。

第十一节 费用

第六十七条 乙方应当向甲方支付期货交易和交割的手续费。手续费收取按照双方约定的《手续费收取标准》执行。甲方收取的手续费包含了交易所收取的手续费。甲方有权根据交易规则变化等情况按照本合同约定的通知事项发布方式与乙方协商并确定手续费标准。如乙方未在规定时间内提出答复,视为乙方同意接受甲方通知的手续费标准。

新上市品种手续费收取标准按甲方通知的手续费收取标准执行;乙方如有异议可与甲方另行协商,否则视为乙方同意接受甲方通知的手续费收取标准。

第六十八条 乙方应当支付甲方向期货交易所、结算机构、银行代付的各项费用及税款。

第十二节 合同生效与变更

第六十九条 本合同经双方签字(乙方为机构客户的须加盖公章)后生效。

第七十条 本合同履行过程中,如果相关法律、法规、规章、政策及期货交易所规则发生变化,甲方有权依照上述变化直接变更本合同与此相关部分的条款,变更或补充条款优先适用。

根据上述情况的变化,甲方对本合同有关条款进行的变更或补充,将以本合同约定的通知方式向乙方发出。变更或补充内容于该内容发出一日后生效。

第七十一条 除本合同第七十条所述情况外,如需变更或者补充本合同,需双方协商一致并签订书面变更或者补充协议。变更或补充协议优先适用。

第七十二条 本合同履行过程中的未列明事宜,按国家有关法律、法规、规章、政策及相关期货交易所的规则、甲

方相关业务规则以及期货交易惯例处理。

第十三节 合同终止与账户清算

第七十三条 甲方向乙方提出解除合同的，应当提前七天以书面形式通知乙方。乙方未按要求期间内自行清理账户的，甲方有权拒绝乙方的新单交易指令及资金调拨指令，乙方应对其账户清算的费用、清算后的债务余额以及由此造成的损失负全部责任。

第七十四条 乙方可以通过撤销账户的方式终止本合同。但在下列情况下，乙方不得撤销账户：

(一) 乙方账户上持有未平仓合约或存在交割遗留问题尚未解决；

(二) 乙方与甲方有未清偿的债权、债务关系；

(三) 乙方与甲方有交易纠纷尚未解决的。

乙方提出终止本合同的，应当办理书面销户手续，并按照甲方规定要求提供相关证件。

第七十五条 当发生下列情形之一时，甲方有权即时解除本合同，并通过平仓或执行质押物对乙方期货账户进行清算，乙方应对甲方进行其期货账户清算的费用和清算后的债务余额承担全部清偿责任。

(一) 乙方具备下列情形之一的：

1、违反《客户须知》的下列行为：

(1) 提供虚假、非法、无效的开户文件和资料的

(2) 要求期货公司做获利保证的

(3) 要求期货公司或其工作人员以全权委托的方式进行期货交易的

(4) 违反期货交易所关于异常交易行为的规定并经劝阻、制止无效的

2、违反本合同第一节第三条的有关承诺的；

3、违反社会公德、妨碍他人正常交易，严重影响甲方正常交易秩序的；

4、违反甲方有关规定，并经劝阻无效的。

(二) 乙方作为自然人已经死亡或丧失民事行为能力，乙方作为机构发生经营期满、倒闭、歇业、清算、被吊销法人资格、未进行或未通过相关部门年检的；

(三) 乙方被人民法院宣告进行破产程序的；

(四) 乙方在甲方的账户被诉讼保全、冻结的；

(五) 乙方出现其他法定或者约定解除合同条件的情况。

第七十六条 甲乙双方均有权随时解除本合同，合同的解除对已发生的交易无溯及力。

第七十七条 甲方因故不能从事期货业务时，应当采取必要措施妥善处理乙方的持仓和保证金。经乙方同意，甲方应将乙方持仓和保证金转移至其他期货公司，由此产生的合理费用由甲方承担。

如乙方因突发事故丧失处理账户的能力，需由法定的最终受益人持相关证明文件理账户清算手续。

第十四节 免责条款

第七十八条 由于地震、火灾、战争等不可抗力因素导致的交易中断、延误等，甲方不承担责任，但应当在条件允许的范围内采取一切必要的补救措施以减少因不可抗力造成的损失。

第七十九条 由于国家有关法律、法规、规章、政策或者期货交易所规则的改变、紧急措施的出台等导致乙方所承担的风险，甲方不承担责任。

第八十条 由于通讯系统繁忙、中断，计算机交易系统故障，网络及信息系统故障，电力中断等原因导致指令传达、执行出现延迟、中断或数据错误，非甲方原因，甲方不承担责任。

第八十一条 由于互联网上黑客攻击、非法登陆等风险的发生给乙方造成的损失，甲方不承担责任。

第十五节 争议解决

第八十二条 凡因本合同引起的或与本合同有关的任何争议，甲乙双方可以自行协商解决或向中国期货业协会申请调解，协商或调解不成的，可以提请仲裁或者提起诉讼；也可以直接提请仲裁或者提起诉讼。

甲乙双方协商按下列选择提请仲裁或提起诉讼（注：请在选项前□内打√，在非选项前□内打×，只能选择其中一项）：

双方另行签署仲裁协议进行仲裁；

向有管辖权的人民法院起诉。

第十六节 其他

第八十三条 甲方应按照国家证监会的规定，及时办理乙方登录中国期货保证金监控中心投资者查询系统的相关事宜。

第八十四条 甲乙双方签订的《期货经纪合同》以及相关附件，其权利义务只涉及甲乙双方。乙方不得利用在甲方开立的账户，以甲方工作人员的身份活动，通过网上交易或其他形式开展期货经纪业务或其他活动。若因乙方过错而使甲方遭受损失和不良影响的，乙方应承担相应的赔偿责任。

第八十五条 本合同未尽事宜，双方另行议定。

第八十六条 《期货交易风险说明书》、《股指期货交易特别风险揭示书》、《客户须知》、《开户申请表》及其他补充协议为本合同不可分割的组成部分，与本合同具有同等法律效力。

第八十七条 本合同一式三份，甲方、甲方营业部或中间介绍商营业部、乙方各执一份。乙方承诺三份签署一致。

第八十八条 本合同除在所列各空白处填写资料外，双方如有其他约定，均须另行签订补充或修改协议，不得在本合同上直接加注。任何在本合同上自行添加的条款或对条款的修改均属无效，不具法律约束力。

甲方： 中证期货有限公司

乙方：

(签字/盖章)： _____

(签字/盖章)： _____

签署日期： 年 月 日

签署日期： 年 月 日

附件:

开户回执

尊敬的客户:

感谢您选择中证期货, 现将重要信息报告如下:

一、交易权限说明

根据您的情况, 我公司特推荐网站中的所有行情、交易软件供您选择使用, 建议您根据您的喜好至少下载两种, 以互为备份。所有行情、交易软件均为第三方机构提供, 我公司将实时监控以尽力为您提供准确、及时、可靠的行情和交易。但是我公司无法对这些软件提供任何保证或担保, 并无法承担使用这些软件可能带来的风险、损失或责任。

(一) 互联网行情、交易软件下载方式

您在我公司交易需要使用的行情、交易软件请通过我公司网站 (www.citicsf.com) “软件下载” 栏目进行下载。

(二) 行情、交易软件用户名、密码

行情软件: 用户名密码为默认 **zzqh**, 下载以后无需输入直接选择站点登录即可。

交易软件: 用户名为**期货资金账号**, 初始交易密码和资金密码为**身份证后六位数字(机构客户为营业执照后六位数字)**。

(三) 密码安全提示

您应立即自行登录网上交易系统并更改初始交易和资金密码。为确保您的账户安全, 您进行网上交易系统的计算机或手机终端应防止感染木马、病毒或被安装恶意程序; 交易系统的账号、密码应避免使用简单密码, 并应定期适时修改; 输入交易系统密码时应防止他人偷看、不向他人泄露密码。

(四) 交易权限开通

您的开户资料符合各项开户要求且我公司监测到您的期货账户初始保证金达到十万以上以后将为您开通合约交易权限。

二、资金管理说明

您开始进行交易前, 应将资金汇入我公司期货保证金专用账户。我公司所有期货保证金专用账户列表在我公司网站“资金存取”中公示。

根据监管规定, 您必须提前登记若干银行账户作为您的期货保证金结算账户。通过这些期货保证金结算账户与我公司进行期货资金的划转和收付。划转和收付操作只能在一家银行内部执行, 不能进行跨行操作。

您需要将资金汇入我公司保证金账户时, 可通过以下两种方式办理:

1、通过银行营业网点、网上银行、电话银行、手机银行、我公司交易系统银期转账模块等方式(使用网上银行、电话银行、手机银行办理银期转账资金划转业务的需提前通过银行开通相应权限)使用银期转账功能提出“银行转期货”指令, 系统经过审核为您自动办理入金手续。

2、通过银行网银、电话银行、柜台等方式(使用网银、电话银行需提前在银行开通相关权限)汇款至我公司保证金账户。

您需要将资金由期货交易账户划出至您开设在银行的期货保证金结算账户时, 可通过以下两种方式办理:

1、通过银行营业网点、网上银行、电话银行、手机银行、我公司交易系统银期转账模块等方式(使用网上银行、电话银行、手机银行办理银期转账资金划转业务的需提前通过银行开通相应权限)使用银期转账功能提出“期货转银行”指令, 系统经过审核为您自动办理出金手续;

2、书面提交出金指令, 我公司经审核通过, 根据书面申请书中约定的汇款方式为您自动办理出金手续。

中证期货有限公司在五大银行的银期代码为:

银行名称	中国农业银行	中国工商银行	中国建设银行	中国银行	交通银行
银期代码	01580000	11390000	018202	00000158	000034

三、经纪关系说明

您与我公司建立了期货经纪服务关系，资金账号为：_____；

为了给您提供良好的服务，我公司的服务人员为：_____；

除我公司外，您选择的居间服务人员为：_____。

四、通知事项说明

通知事项包括并不限于交易所交易规则变更通知，期货公司保证金、手续费等交易和结算参数调整通知，客户交易结算报告，追加保证金通知，强行平仓通知，期货公司交易系统、行情系统、网站变更通知。

您可通过我公司网站（www.citicsf.com）、行情系统等方式查询交易和结算参数调整通知以及交易所交易规则、交易系统、行情系统、网站等变更通知。

您可通过中国期货保证金监控中心客户查询系统（www.cfmmc.com）查询您的交易结算报告、追加保证金通知、强行平仓通知、调整保证金通知等通知事项。

中国期货保证金监控中心查询系统用户名及密码获取方式如下：

中国期货保证金监控中心查询系统	用户名	密码
中国期货保证金监控中心	0158+资金账号	开户成功后短信或电话告知 (开户申请表中预留的联系方式)

五、研报服务说明

您可登录我公司网站（www.citicsf.com）查询研究报告、相关资讯等。我公司所有评论及分析均不构成交易指导，仅供参考。据此类信息操作，一切后果由您自行承担。

六、投资咨询说明

我公司可根据您的需要为您定制风险管理咨询、投资策略、套期保值等方案，您可根据您的交易需要向我公司提出相关定制需求。

七、资产管理说明

我公司资产管理业务必须通过我公司资产管理部开展。如您需要委托我公司开展资产管理业务，必须与我公司签署资产管理合同后按照相关规定开展。除资产管理部以外的公司员工，均不具有开展资产管理业务的资格。

八、应急处理说明

如您无法正常进行期货交易等业务，请及时拨打服务热线。客服电话：4006789819。

如您对我公司有任何异议请立即书面传真或当面递交至我公司营业网点。

再次感谢您选择我们公司，祝投资顺利！

中证期货有限公司

投资者签收：

日期： 年 月 日